

Varyasyon Katsayısı Nedir?

Çalışma Kağıdı

Varyasyon katsayısı, standart sapmanın ortalamaya oranıdır ve bir veri setinin ortalamasına göre ne kadar değişken olduğunu gösterir. Düşük bir varyasyon katsayısı, daha düşük oynaklık ve daha istikrarlı getiriler anlamına gelir.

$$VK = \sigma/\mu$$

σ = Standart Sapma

μ = Ortalama Getiri

Sorular

1. Varyasyon katsayısı neyi ölçer?

- A) Mutlak oynaklığı
- B) Ortalamaya göre göreceli oynaklığı
- C) Veri setinin boyutunu
- D) Getirilerin toplamını

2. Eğer bir yatırımın ortalama getirisi yüksek ve varyasyon katsayısı düşükse, bu ne anlama gelir?

- A) Yüksek risk, düşük getiri
- B) Düşük risk, yüksek getiri
- C) Yüksek risk, yüksek getiri
- D) Düşük risk, düşük getiri

3. Ortalama getirisi 50 olan bir veri setinin standart sapması 10 ise, varyasyon katsayısı kaçtır?

- A) 0.2
- B) 5
- C) 0.5
- D) 2

4. İki farklı hisse senedinin (A ve B) getirilerini karşılaştıralım. Hisse Senedi A'nın ortalama getirisi %10 ve standart sapması %5 iken, Hisse Senedi B'nin ortalama getirisi %20 ve standart sapması %8'dir. Hangi hisse senedi daha az risklidir?

5. Bir yatırım fonunun son 5 yıldaki yıllık getirileri sırasıyla %8, %12, %6, %10, %14'tür. Bu fonun varyasyon katsayısını hesaplayın.

6. Tanımla: Varyasyon Katsayısı (VK) nedir?

7. Tanımla: VK formülü nedir?

8. Tanımla: Düşük varyasyon katsayısı ne anlama gelir?

Cevap Anahtarı

1. B) Ortalamaya göre göreceli oynaklığı — Varyasyon katsayısı, standart sapmanın ortalamaya oranı olduğu için, ortalamaya göre göreceli oynaklığı ölçer.
2. B) Düşük risk, yüksek getiri — Yüksek ortalama getiri ve düşük varyasyon katsayısı, yatırımın hem iyi getiri sağladığını hem de bu getirilerin nispeten istikrarlı olduğunu gösterir.
3. A) 0.2 — $VK = \text{Standart Sapma} / \text{Ortalama} = 10 / 50 = 0.2$
4. 1. Hisse Senedi A için Varyasyon Katsayısı'nı hesaplayın: $VK_A = \%5 / \%10 = 0.5$. 2. Hisse Senedi B için Varyasyon Katsayısı'nı hesaplayın: $VK_B = \%8 / \%20 = 0.4$. 3. Sonuçları karşılaştırın: $VK_B (0.4) < VK_A (0.5)$. Bu, Hisse Senedi B'nin Hisse Senedi A'ya göre daha düşük bir göreceli risk taşıdığı anlamına gelir.
5. 1. Yıllık getirilerin ortalamasını hesaplayın: $(8+12+6+10+14)/5 = 10$. 2. Yıllık getirilerin standart sapmasını hesaplayın (yaklaşık 2.92). 3. Varyasyon katsayısını hesaplayın: $VK = 2.92 / 10 = 0.292$.
6. Standart sapmanın ortalamaya oranıdır; ortalamaya göre göreceli yayılımı ölçer.
7. $VK = \text{Standart Sapma} / \text{Ortalama Getiri}$
8. Daha düşük oynaklık ve daha istikrarlı getiriler.

Bounlu

Tüm kartlar, adım adım çözümler ve AI hoca desteği Notek uygulamasında.
Sınav tarihlerini Promy otomatik hatırlatıcıya çevirir.